

**Ausschreibung einer Diplomarbeit/Masterthesis am
Institut für Angewandte Informatik und Formale Beschreibungsverfahren**

Szenarioanalyse im Risikomanagement von Unternehmen – dynamische Optimierung unter Unsicherheit

In Unternehmen kommen zur Bewertung des Risikos Szenarioanalysen zum Einsatz. In dem Zusammenhang werden zur Beginn der Analyse bestimmte Parameterannahmen getroffen, um diese Risiken zu quantifizieren und einen Szenarienbaum aufbauen zu können. Diese Art der Risikoberechnung ist kurzfristig stabil zu beurteilen, langfristig spielen jedoch dynamische Prozesse eine wichtige Rolle.

In der Diplomarbeit soll zunächst allgemein auf die Bewertungsmethodik von Unternehmensrisiken mittels Szenarioanalysen eingegangen werden. Unter anderem sollen hierbei interne und externe Risikofaktoren erörtert werden.

Unternehmen legen ihre Investitions- und Anlagestrategie auf Basis solcher Risikoszenarien aus. In der Diplomarbeit soll hierzu prototypisch ein Verfahren bzw. Algorithmus entwickelt werden, der synchron für ein mehrperiodisches Modell, die beste Anlagestrategie ermittelt. Die erörterten Risikofaktoren sollen dabei geeignet in die Modellierung einfließen.

Kontaktinformation

Bei Interesse bitte Kontakt aufnehmen mit:

Andreas Vogel
andreas.vogel@aifb.uni-karlsruhe.de

Die Diplomarbeit / Masterthesis wird betreut von Prof. Dr. D. Seese.
Institut AIFB. Gruppe Komplexitätsmanagement.